

附件 1

修订说明

为服务国家高水平对外开放战略，助力上海国际金融中心建设，提升重要大宗商品价格影响力，经证监会同意将镍期货及期权品种作为境内特定品种，上海期货交易所（以下简称上期所）全面引入境外特殊参与者、境外中介机构和境外客户（以下简称“境外参与者”）参与镍期货及期权交易，相应修订《上海期货交易所镍期货业务细则》。主要内容如下：

一是参与主体方面，增加“境外特殊参与者、境外中介机构、境外客户”，明确其作为市场参与主体，可以参与镍期货交易。在《上海期货交易所镍期货业务细则》第二条中，增加“境外特殊参与者、境外中介机构、境外客户”应当遵守本细则。

二是持仓退出方面，增加镍期货移仓情形，明确申请移仓主体、移仓程序以及移仓内容。在《上海期货交易所镍期货业务细则》中增加第十三条、第十四条和第十五条的移仓规定。**首先，第十三条明确移仓主体为“符合条件的移出方可以向交易所申请移仓给符合条件的移入方。移出方、移入方可以为客户、非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者。”其次，第十四条和第十五条第一款明确移仓程序为“移仓申请应当在交易所规定的时间内提交。移出方提出移仓申请，经移入方确认后，提交至交易所。移出方或移入方为客户时，通过期货公司会员办理移仓申请。移出方或移入方为境外特殊非经纪参与者时，通过其委托结算的期**

货公司会员办理移仓申请。移出方或移入方为非期货公司会员时，自行办理移仓申请”“交易所收到移仓申请后，审核移入方、移出方资格，对于通过资格审核的申请，当日办理移仓”。**再次，第十五条第二款明确移仓内容为“移仓内容仅包括持仓。”最后，规定“移仓业务具体要求由交易所另行规定。”**

三是风控制度方面，增加境外参与者在持仓限额、持仓整倍数、强制减仓上的具体规定。在《上海期货交易所镍期货业务细则》第三十一条中增加境外特殊非经纪参与者以明确境外参与者在不同时期的限仓比例和限仓数额；在第三十二条和第三十三条的“交易者”类型中增加“境外特殊非经纪参与者”以明确境外参与者进入交割月后适用持仓整倍数规定和强制减仓规定。